

FORECASTING CREDIT PORTFOLIO RISK

Prezzo: **Prezzo di listino**
12,00 € **Prezzo a te riservato**
11,40 €



Francesco Campanella
Luana Serino

Forecasting credit portfolio risk

Analisi e valutazione delle insolvenze



Codice	9788891635686
Tipologia	Libri
Data pubblicazione	19 giu 2019
Reparto	Economia, LIBRI
Argomento	Economia generale
Autore	Campanella Francesco, Serino Luana
Editore	Maggioli

Descrizione

Questo libro costituisce una guida ai modelli di gestione del credit risk adottabili dall'istituzione bancaria, tracciando un percorso graduale che parte dall'illustrazione dei primi strumenti statistici elementari, fino ad approcci via via più complessi. Poiché la ricerca di nuovi approcci al credit risk non si è mai interrotta, l'impianto di calcolo dei modelli è stato affinato nel corso del tempo, giungendo alla sperimentazione e definizione dei modelli di portafoglio, che costituiscono il vero focus del libro. L'intera analisi viene effettuata tenendo in considerazione il solido impianto teorico alla base dei modelli, senza trascurarne le peculiarità ed i limiti concreti. Pertanto, gli autori non si limitano a descrivere, ma operano un'analisi critica del variegato mondo dei modelli di forecasting. Il valore aggiunto del testo consiste nell'analisi dettagliata dei modelli di previsione delle insolvenze giudicati maggiormente rilevanti, svolta tenendo conto del legame fra l'indagine storica retrospettiva e il processo evolutivo dei modelli statistici, senza trascurare l'informazione e l'attualità più stretta. Infatti, la parte finale del lavoro è dedicata alla trattazione degli aspetti salienti delle macro-novità regolamentari attese da Basilea IV, che mirano sia ad incrementare la sensibilità al rischio, sia a garantire maggiore uniformità e comparabilità tra gli istituti bancari per quanto concerne la determinazione del rating.

Il volume è un valido strumento per facilitare il percorso di apprendimento e di approfondimento dei forecasting models, così da essere adatto sia alle esigenze degli studenti sia a coloro che vogliono analizzare una tematica in continua evoluzione.

Rimaniamo a disposizione per qualsiasi ulteriore chiarimento allo 0461.232337 o 0461.980546 oppure via mail a : servizioclienti@libriprofessionali.it

www.LibriProfessionali.it è un sito di Scala snc Via Solteri, 74 38121 Trento (Tn) P.Iva 01534230220

